

# Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro de 2018

Carteira consolidada de investimentos - base (janeiro / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.500.034,82	1,05%	197	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	794.218,23	0,24%	17	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	4.323.588,78	1,29%	52	1,49%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	811.201,27	0,24%	203	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	4.320.320,65	1,29%	193	1,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.408.371,01	0,42%	1.220	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.114.821,34	0,93%	197	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	24.571.504,36	7,35%	720	0,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	7.790.868,74	2,33%	346	0,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	43.029.382,76	12,88%	223	1,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	2.685.264,14	0,80%	143	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	16.503.131,02	4,94%	734	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	4.506.253,62	1,35%	22	1,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	6.623.031,77	1,98%	1.418	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	3.084.524,43	0,92%	23	12,79%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.670.070,58	1,70%	625	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	7.010.569,84	2,10%	110	0,88%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	7.209.225,57	2,16%	685	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	909.312,27	0,27%	707	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.687.348,74	1,10%	36	1,58%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.430.074,34	0,43%	234	0,27%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	22.288.664,35	6,67%	310	0,88%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "

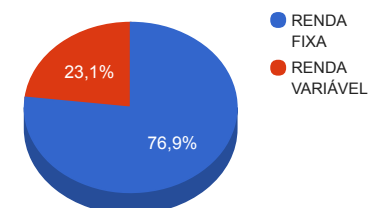
Carteira consolidada de investimentos - base (janeiro / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	2.888.154,86	0,86%	15	0,81%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.167.796,35	0,35%	99	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.185.370,83	1,25%	236	0,39%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	31.251.143,44	9,35%	425	1,56%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	6.873.407,21	2,06%	756	0,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	31.125.566,97	9,32%	506	0,33%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	1.402.410,00	0,42%	100	0,61%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	1.781.700,59	0,53%	60	0,41%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	22.859.327,24	6,84%	3.983	7,04%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	3.280.896,74	0,98%	30	6,17%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	D+4	Não há	3.465.128,74	1,04%	6.782	2,21%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB PIPE FIC AÇÕES	D+4	03/06/2018	1.379.595,10	0,41%	43	1,13%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	D+4	Não há	7.053.115,47	2,11%	4.452	5,99%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	10.243.806,02	3,07%	923	0,89%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	3.541.941,86	1,06%	524	5,24%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB CIELO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.970.019,11	0,59%	4.553	1,58%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB CONSUMO FIC AÇÕES	D+4	Não há	4.004.239,39	1,20%	3.045	2,73%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
XP INVESTOR FI AÇÕES	D+4	Não há	2.789.704,54	0,83%	4.939	0,60%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.765.918,26	0,53%	6.316	0,45%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	2.337.823,09	0,70%	36	1,04%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	12.546.292,67	3,76%	13.704	0,92%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	913.626,47	0,27%	7	0,64%	Desenquadrado - RF
<b>TOTAL -</b>			<b>334.098.767,58</b>				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (janeiro / 2018)

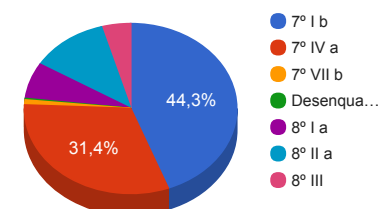
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	147.865.695,20	44,26%	15,00%	25,00%	70,00%	86.003.442,11
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	200.459.260,55
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	104.897.527,09	31,40%	5,00%	10,00%	30,00%	-4.667.896,82
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	7,00%	15,00%	15,00%	50.114.815,14
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	16.704.938,38
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	3.184.110,59	0,95%	2,00%	5,00%	5,00%	13.520.827,79
Desenquadrado - RF	0,00%	913.626,47	0,27%	0,00%	0,00%	0,00%	-913.626,47
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>256.860.959,35</b>	<b>76,88%</b>	<b>36,00</b>	<b>70,00</b>	<b>190,00</b>	<b>-</b>

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	22.859.327,24	6,84%	2,00%	5,00%	10,00%	10.550.549,52
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	39.494.365,23	11,82%	2,00%	5,00%	10,00%	-6.084.488,47
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	14.884.115,76	4,46%	7,00%	10,00%	10,00%	18.525.761,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	16.704.938,38
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	16.704.938,38
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>77.237.808,23</b>	<b>23,12%</b>	<b>15,00</b>	<b>30,00</b>	<b>40,00</b>	<b>-</b>

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: janeiro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	147.865.695,20	44,26%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	104.897.527,09	31,40%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	7,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	3.184.110,59	0,95%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RF	913.626,47	0,27%	0,00%	0,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>256.860.959,35</b>	<b>76,88%</b>	<b>36,00</b>	<b>190,00</b>

Artigos - Renda Variável	Base: janeiro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	22.859.327,24	6,84%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	39.494.365,23	11,82%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	14.884.115,76	4,46%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>77.237.808,23</b>	<b>23,12%</b>	<b>15,00</b>	<b>40,00</b>

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (janeiro / 2018)

Artigo 14º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	163.728.765,29	49,01%	0,04%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	81.596.272,12	24,42%	0,01%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	53.235.087,92	15,93%	0,01%
WESTERN ASSET	15.797.742,23	4,73%	0,03%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	7.790.868,74	2,33%	0,00%
SAFRA ASSET MANAGEMENT	7.394.408,48	2,21%	0,00%
XP GESTÃO DE RECURSOS	4.555.622,80	1,36%	0,00%

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (janeiro / 2018)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 20 Anos	8,56%	8,56%	6,28%	8,94%	17,71%	88,23%	-	-	-
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6,19%	6,19%	4,38%	6,99%	15,27%	65,00%	0,20%	3,853%	17,25%
IMA-B 5+	4,95%	4,95%	4,29%	7,16%	15,74%	53,21%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4,91%	4,91%	4,20%	6,98%	15,45%	52,37%	0,20%	2,748%	11,80%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	4,88%	4,88%	4,18%	6,92%	15,24%	52,07%	0,20%	2,759%	12,08%
IMA-B	3,40%	3,40%	3,46%	6,35%	14,49%	42,84%	-	-	-
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	3,58%	3,58%	3,60%	6,29%	15,19%	43,94%	0,50%	2,093%	10,14%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,37%	3,37%	3,39%	6,21%	14,24%	42,39%	0,20%	1,795%	9,09%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	3,37%	3,37%	3,38%	6,17%	13,93%	41,83%	0,20%	1,804%	9,11%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,35%	3,35%	3,42%	6,27%	14,41%	42,42%	0,30%	1,793%	9,10%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	3,33%	3,33%	3,40%	6,18%	14,14%	39,75%	0,45%	1,879%	9,41%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	3,30%	3,30%	3,39%	6,25%	13,92%	41,75%	0,20%	1,806%	8,69%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3,05%	3,05%	2,77%	3,20%	8,77%	26,80%	0,20%	1,550%	7,92%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,05%	1,05%	1,61%	1,04%	4,30%	10,82%	0,20%	0,350%	4,31%
IMA Geral	1,76%	1,76%	2,66%	5,28%	12,77%	36,16%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,68%	1,68%	2,54%	5,03%	12,50%	35,78%	0,20%	0,845%	4,39%
IRF-M 1+	1,55%	1,55%	2,94%	5,81%	15,40%	47,98%	-	-	-

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (janeiro / 2018)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,66%	1,66%	2,98%	5,59%	14,97%	47,80%	0,20%	1,178%	5,89%
IMA-B 5	1,33%	1,33%	2,33%	5,17%	12,77%	27,94%	-	-	-
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	1,31%	1,31%	2,31%	5,09%	12,57%	27,47%	0,10%	0,609%	3,44%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,31%	1,31%	2,28%	5,06%	12,57%	27,44%	0,20%	0,609%	3,43%
IRF-M	1,30%	1,30%	2,65%	5,38%	14,09%	40,05%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,29%	1,29%	2,59%	5,25%	13,78%	39,58%	0,20%	0,887%	4,50%
IPCA + 6,00% ao ano	0,80%	0,80%	2,47%	4,80%	8,95%	21,70%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,18%	2,18%	2,68%	5,72%	14,43%	38,93%	0,15%	1,325%	6,31%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,09%	1,09%	2,64%	5,10%	9,46%	23,44%	0,20%	0,241%	0,35%
IDKA IPCA 2 Anos	0,77%	0,77%	2,20%	4,96%	13,25%	27,12%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,04%	1,04%	1,61%	3,84%	10,22%	23,85%	0,20%	0,345%	1,66%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,96%	0,96%	2,12%	4,80%	12,27%	26,56%	0,20%	0,451%	2,69%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,95%	0,95%	2,06%	4,74%	12,22%	26,72%	0,20%	0,448%	2,62%
IRF-M 1	0,59%	0,59%	1,79%	4,11%	10,35%	26,16%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,59%	0,59%	1,74%	4,00%	10,12%	25,62%	0,10%	0,109%	0,65%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,57%	0,57%	1,75%	4,00%	10,18%	25,74%	0,20%	0,112%	0,66%



Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (janeiro / 2018)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,57%	0,57%	1,74%	4,02%	10,18%	25,79%	0,20%	0,097%	0,65%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	0,57%	0,57%	1,80%	4,14%	10,42%	26,64%	0,50%	0,155%	1,08%
Selic	0,58%	0,58%	1,70%	3,84%	9,39%	24,77%	-	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,57%	0,57%	1,67%	4,03%	9,79%	25,49%	0,20%	0,001%	0,14%
CDI	0,58%	0,58%	1,70%	3,83%	9,38%	24,73%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,57%	0,57%	1,73%	3,90%	9,51%	24,76%	0,20%	0,021%	0,13%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,57%	0,57%	1,69%	3,82%	9,33%	24,61%	0,20%	0,019%	0,16%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,51%	0,51%	1,49%	3,41%	8,50%	22,70%	0,80%	0,000%	0,11%
IPCA	0,29%	0,29%	1,01%	1,79%	2,86%	8,36%	-	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1,36%	1,36%	2,55%	5,72%	14,87%	36,01%	0,20%	0,635%	4,08%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,99%	0,99%	1,75%	3,68%	9,48%	24,35%	0,20%	0,233%	1,28%

Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (janeiro / 2018)

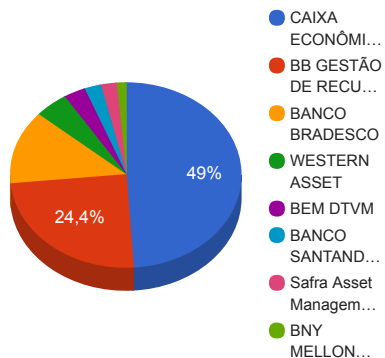
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFNC	19,28%	19,28%	19,61%	33,88%	38,11%	130,48%	-	-	-
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	18,84%	18,84%	18,95%	32,53%	35,58%	123,60%	1,00%	10,827%	22,43%
CIELO ON NM - CIEL3	14,29%	14,29%	20,71%	5,17%	25,72%	20,46%	-	-	-
BB CIELO FI AÇÕES	14,05%	14,05%	20,11%	4,47%	23,85%	16,71%	1,50%	13,657%	26,17%
Ibovespa	11,14%	11,14%	14,27%	28,81%	31,30%	110,15%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	9,97%	9,97%	11,01%	27,22%	26,28%	78,34%	1,00%	8,290%	18,77%
XP INVESTOR FI AÇÕES	9,02%	9,02%	10,68%	23,18%	29,32%	115,07%	2,00%	8,580%	18,11%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	7,28%	7,28%	6,30%	18,49%	25,77%	90,05%	2,00%	8,829%	18,99%
BB PIPE FIC AÇÕES	3,55%	3,55%	6,29%	18,33%	29,09%	67,68%	1,20%	7,085%	15,91%
IDIV	9,88%	9,88%	7,63%	22,52%	26,79%	144,24%	-	-	-
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	11,32%	11,32%	14,19%	24,94%	31,94%	101,44%	1,50%	8,106%	18,32%
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	5,48%	5,48%	9,61%	11,56%	20,05%	85,51%	3,00%	6,865%	16,53%
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	9,20%	9,20%	12,19%	16,85%	18,33%	51,83%	-	-	-
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	8,98%	8,98%	11,68%	15,61%	16,06%	46,33%	1,5%	10,657%	24,11%
S&P 500	5,62%	5,62%	9,65%	14,31%	23,91%	45,54%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	5,38%	5,38%	10,74%	17,37%	33,69%	78,17%	1,00%	4,064%	6,53%
SMLL	4,34%	4,34%	8,96%	20,84%	39,86%	124,46%	-	-	-

Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (janeiro / 2018)

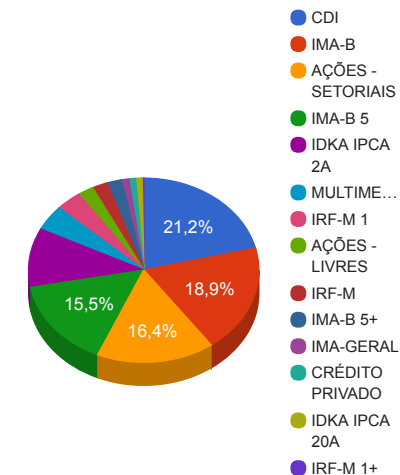
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	4,57%	4,57%	9,21%	22,44%	40,68%	97,70%	1,50%	6,814%	18,12%
ICON	1,36%	1,36%	4,45%	18,98%	30,65%	60,40%	-	-	-
BB CONSUMO FIC AÇÕES	1,35%	1,35%	4,04%	18,01%	28,62%	55,79%	1,00%	6,696%	16,95%
CDI	0,58%	0,58%	1,70%	3,83%	9,38%	24,73%	-	-	-
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1,12%	1,12%	1,64%	4,30%	7,83%	26,25%	2,00%	0,643%	1,65%

Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (janeiro / 2018)

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	163.728.765,29	49,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	81.596.272,12	24,42%
BANCO BRADESCO	42.991.281,90	12,87%
WESTERN ASSET	15.797.742,23	4,73%
BEM DTVM	10.243.806,02	3,07%
BANCO SANTANDER	7.790.868,74	2,33%
Safra Asset Management	7.394.408,48	2,21%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	4.555.622,80	1,36%



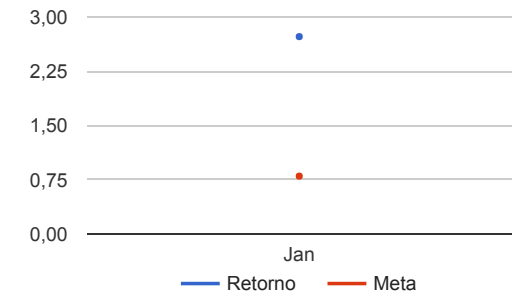
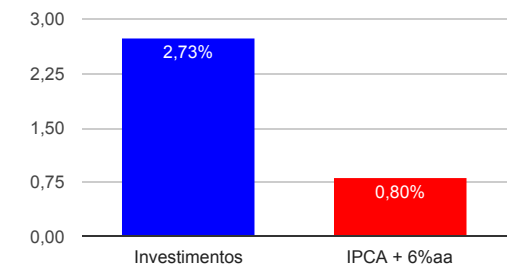
Sub-segmento	Valor	%
CDI	70.680.191,96	21,16%
IMA-B	63.210.687,28	18,92%
AÇÕES - SETORIAIS	54.903.496,09	16,43%
IMA-B 5	51.729.563,77	15,48%
IDKA IPCA 2A	34.561.895,59	10,34%
MULTIMERCADO	14.884.115,76	4,46%
IRF-M 1	12.087.353,99	3,62%
AÇÕES - LIVRES	7.450.196,38	2,23%
IRF-M	7.209.225,57	2,16%
IMA-B 5+	6.802.170,08	2,04%
IMA-GERAL	3.500.034,82	1,05%
CRÉDITO PRIVADO	3.184.110,59	0,95%
IDKA IPCA 20A	3.084.524,43	0,92%
IRF-M 1+	811.201,27	0,24%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	325.218.072,19	12.171.088,33	12.155.217,07	334.098.767,58	8.864.824,13	2,73%	0,80%	340,08%	2,25%
Acumulado no ano					8.864.824,13	2,73%	0,80%	340,08%	

**Acumulado no Ano**



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de janeiro / 2018

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.904.796,48	0,00	0,00	3.084.524,43	179.727,95	6,19%	3,85%	6,19%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.969.036,90	0,00	0,00	3.114.821,34	145.784,44	4,91%	2,75%	4,91%
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	3.515.862,36	0,00	0,00	3.687.348,74	171.486,38	4,88%	2,76%	4,88%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	882.056,17	0,00	0,00	913.626,47	31.570,30	3,58%	2,09%	3,58%
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	6.782.158,40	0,00	0,00	7.010.569,84	228.411,44	3,37%	1,80%	3,37%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	15.873.663,59	91.908,99	0,00	16.503.131,02	537.558,44	3,37%	1,80%	3,37%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.049.824,94	0,00	0,00	4.185.370,83	135.545,89	3,35%	1,79%	3,35%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	4.361.235,57	0,00	0,00	4.506.253,62	145.018,05	3,33%	1,88%	3,33%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	21.561.500,03	15.018,42	0,00	22.288.664,35	712.145,90	3,30%	1,81%	3,30%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	770.721,32	0,00	0,00	794.218,23	23.496,91	3,05%	1,55%	3,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.231.391,56	0,00	0,00	4.323.588,78	92.197,22	2,18%	1,32%	2,18%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.442.161,33	0,00	0,00	3.500.034,82	57.873,49	1,68%	0,84%	1,68%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	797.983,55	0,00	0,00	811.201,27	13.217,72	1,66%	1,18%	1,66%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.757.826,92	0,00	0,00	1.781.700,59	23.873,67	1,36%	0,63%	1,36%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	7.690.053,80	0,00	0,00	7.790.868,74	100.814,94	1,31%	0,61%	1,31%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	897.578,67	0,00	0,00	909.312,27	11.733,60	1,31%	0,61%	1,31%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.117.619,24	0,00	0,00	7.209.225,57	91.606,33	1,29%	0,89%	1,29%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.656.439,83	0,00	0,00	2.685.264,14	28.824,31	1,09%	0,24%	1,09%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	42.584.228,32	0,00	0,00	43.029.382,76	445.154,44	1,05%	0,35%	1,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.275.960,97	0,00	0,00	4.320.320,65	44.359,68	1,04%	0,34%	1,04%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.388.698,00	0,00	0,00	1.402.410,00	13.712,00	0,99%	0,23%	0,99%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	24.337.243,06	0,00	0,00	24.571.504,36	234.261,30	0,96%	0,45%	0,96%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de janeiro / 2018

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.616.511,38	0,00	0,00	5.670.070,58	53.559,20	0,95%	0,45%	0,95%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.400.176,68	0,00	0,00	1.408.371,01	8.194,33	0,59%	0,11%	0,59%
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	30.947.801,98	0,00	0,00	31.125.566,97	177.764,99	0,57%	0,00%	0,57%
BRADERCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1.161.141,15	0,00	0,00	1.167.796,35	6.655,20	0,57%	0,11%	0,57%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.834.379,86	0,00	0,00	6.873.407,21	39.027,35	0,57%	0,02%	0,57%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.585.503,67	0,00	0,00	6.623.031,77	37.528,10	0,57%	0,10%	0,57%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	2.871.808,93	0,00	0,00	2.888.154,86	16.345,93	0,57%	0,15%	0,57%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	37.745.124,57	0,00	6.700.000,00	31.251.143,44	206.018,87	0,55%	0,02%	0,57%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	318.172,04	6.564.160,92	5.455.217,07	1.430.074,34	2.958,45	0,04%	0,00%	0,51%
Total Renda Fixa					4.016.426,82	1,55%	0,73%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de janeiro / 2018

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	5.934.952,99	0,00	0,00	7.053.115,47	1.118.162,48	18,84%	10,83%	18,84%
BB CIELO FI AÇÕES	1.727.360,89	0,00	0,00	1.970.019,11	242.658,22	14,05%	13,66%	14,05%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	2.983.398,94	0,00	0,00	3.280.896,74	297.497,80	9,97%	8,29%	9,97%
XP INVESTOR FI AÇÕES	2.558.799,10	0,00	0,00	2.789.704,54	230.905,44	9,02%	8,58%	9,02%
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	3.179.628,71	0,00	0,00	3.465.128,74	285.500,03	8,98%	10,66%	8,98%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	3.301.653,47	0,00	0,00	3.541.941,86	240.288,39	7,28%	8,83%	7,28%
BRANCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	4.168.679,68	5.500.000,00	0,00	10.243.806,02	575.126,34	5,95%	8,11%	11,32%
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.674.152,81	0,00	0,00	1.765.918,26	91.765,45	5,48%	6,87%	5,48%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	11.905.403,55	0,00	0,00	12.546.292,67	640.889,12	5,38%	4,06%	5,38%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	21.860.179,19	0,00	0,00	22.859.327,24	999.148,05	4,57%	6,81%	4,57%
BB PIPE FIC AÇÕES	1.332.280,58	0,00	0,00	1.379.595,10	47.314,52	3,55%	7,09%	3,55%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	3.950.881,86	0,00	0,00	4.004.239,39	53.357,53	1,35%	6,70%	1,35%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	2.312.039,15	0,00	0,00	2.337.823,09	25.783,94	1,12%	0,64%	1,12%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>4.848.397,31</b>	<b>6,70%</b>	<b>7,28%</b>	